

## عنوان مقاله:

قیمت گذاری اختیار معامله بر روی سهام

## محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی اقتصاد، مدیریت، حسابداری با رویکرد ارزش آفرینی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: ۱۸ صفحه

## نویسندگان:

سعید شهابی نژاد - کارشناس ارشد حسابداری - دانشگاه آزاد واحد کرمان  
مهدي بهار مقدم - دانشيار حسابداری دانشگاه شهید باهنر کرمان

## خلاصه مقاله:

در این تحقیق مروری داریم بر نحوه قیمت گذاری برگهای اختیار معامله بر روی سهام و مقالات داخلی و خارجی مختلفی را در این زمینه بررسی کردیم مدل های بررسی شده مفروضات متفاوتی داشتند ولی بیشتر آنها بر قیمت گذاری روی اختیار معامله های اروپایی و از نوع اختیار خرید تاکید داشتند و از طریق رابطه برابری اختیار خرید و فروش مدل خود را به اختیار فروش اروپایی نیز بسط دادند و برخی نیز به قیمت گذاری اختیار معامله های آمریکایی اشاره کردند . از نظر تاریخ ارائه مدل میتوان آنها را به دو قسمت قبل از مدل ارائه شده توسط S-B در سال ۱۹۷۳ و بعد از آن اشاره کرد تنوع مدل های قبل از مدل ارائه شده توسط S-B زیاد است و تلاش های زیادی در این مقطع صورت گرفته است اما مدل های ارائه شده بعد از تاریخ ۱۹۷۳ بیشتر مدل ارائه شده توسط S-B را به عنوان پایه تحقیقات خود انتخاب کردند و در جهت آزمون بهینه سازی و تعمیم و حذف برخی مفروضات این مدل تلاش کرده اند

## کلمات کلیدی:

مدل های قیمت گذاری . اختیار معامله . فرایند استوکاستکی قیمت فرایند وینر. مدل S-B

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیولیکا:

[https://www.civilica.com/Paper-MAVC03-MAVC03\\_121.html](https://www.civilica.com/Paper-MAVC03-MAVC03_121.html)

این صفحه به معنای تاییدیه نمایه سازی مقاله در پایگاه استنادی سیولیکا می باشد. در هر لحظه به منظور تایید اصالت این گواهی می توانید وضعیت ثبت مقاله را از طریق لینک فوق به صورت آنلاین کنترل نمایید.